

## กองทุนเปิดกรุงศรีหุ้นไดนามิกเพื่อการเลี้ยงชีพ

KFDNMRMF

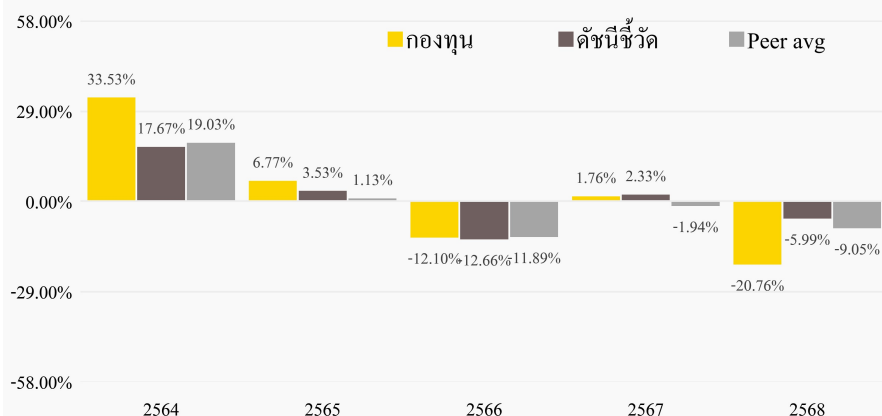
### ประเภทกองทุนรวม / กลุ่มกองทุนรวม

- กองทุนรวมตราสารทุน/ กองทุนรวมเพื่อการเลี้ยงชีพ
- กองทุนรวมที่เน้นลงทุนแบบไม่มีความเสี่ยงในต่างประเทศ
- กลุ่มกองทุนรวม : Equity General

### นโยบายและกลยุทธ์การลงทุน

- ลงทุนในหุ้นที่จดทะเบียนในตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย และ/หรือตลาดหลักทรัพย์ เอ็ม เอ ไอ ตราสารทุน หรือสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) ที่อ้างอิงกับผลตอบแทนของหุ้นหรือกลุ่มหุ้นของบริษัทจดทะเบียนข้างต้น รวมถึงหุ้นที่อยู่ในระหว่าง IPO โดยเฉลี่ยในรอบปีบัญชีไม่น้อยกว่าร้อยละ 80 ของ NAV
- ส่วนที่เหลืออาจลงทุนตราสารแห่งหนี้ ตราสารกึ่งหนี้กึ่งทุน ตราสารทางการเงินหรือเงินฝาก ใบสำคัญแสดงสิทธิอนุพันธ์ หรือหน่วยลงทุนของกองทุนรวม
- กองทุนอาจจะเข้าทำสัญญาซื้อขายล่วงหน้า (Derivatives) เพื่อเพิ่มประสิทธิภาพการบริหารการลงทุน (Efficient Portfolio Management) ซึ่งรวมถึงการป้องกันความเสี่ยง (Hedging) จากการลงทุน
- กองทุนมุ่งหวังให้ผลประกอบการสูงกว่าดัชนีชี้วัด (Active management)

### ผลการดำเนินงานและดัชนีชี้วัดย้อนหลัง 5 ปีปฏิทิน (% ต่อปี)



\* ในปีที่กองทุนจัดตั้ง ผลการดำเนินงานจะแสดงตั้งแต่วันที่จัดตั้งจนถึงสิ้นปีปฏิทิน

### ผลการดำเนินงานย้อนหลังแบบปักหมุด (% ต่อปี)

|                          | YTD    | 3 เดือน | 6 เดือน | 1 ปี *         |
|--------------------------|--------|---------|---------|----------------|
| กองทุน                   | 1.57   | -1.87   | -3.17   | -13.47         |
| ดัชนีชี้วัด              | 5.24   | 1.56    | 8.28    | 5.39           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | 3.99   | 1.69    | 5.23    | 0.24           |
| ความผันผวนกองทุน         | 16.21  | 14.21   | 15.03   | 18.96          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 16.58  | 14.70   | 14.20   | 17.92          |
|                          | 3 ปี * | 5 ปี *  | 10 ปี * | ตั้งแต่จัดตั้ง |
| กองทุน                   | -10.30 | 0.05    | N/A     | -2.21          |
| ดัชนีชี้วัด              | -4.08  | 1.25    | N/A     | 0.54           |
| ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกัน | -6.82  | -0.83   | N/A     | N/A            |
| ความผันผวนกองทุน         | 15.12  | 13.96   | N/A     | 16.60          |
| ความผันผวนดัชนีชี้วัด    | 14.12  | 13.00   | N/A     | 16.13          |

\* ผลตอบแทนที่มีอายุเกินหนึ่งปีจะแสดงผลตอบแทนต่อปี

ค่าเฉลี่ยในกลุ่มเดียวกันตามกลุ่ม Equity General

### ระดับความเสี่ยง



เสี่ยงสูง

ลงทุนในตราสารทุนเป็นหลักโดยเฉลี่ยในรอบปี  
ไม่น้อยกว่า 80% ของ NAV

### ข้อมูลกองทุนรวม

|                        |                     |
|------------------------|---------------------|
| วันจดทะเบียนกองทุน     | 23 พฤศจิกายน 2561   |
| นโยบายการจ่ายเงินปันผล | ไม่จ่าย             |
| อายุกองทุน             | ไม่กำหนดอายุโครงการ |

### ผู้จัดการกองทุนรวม

นาย ทลิต โชคทิพย์พัฒนา (30 ตุลาคม 2563)

นาย ปิติ ประดิษฐ์พงษ์ (1 ตุลาคม 2564)

### ดัชนีชี้วัด

ดัชนีผลตอบแทนรวมตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (SET TRI)  
วัตถุประสงค์การอ้างอิงดัชนีชี้วัด: บริษัทจัดการใช้ดัชนีชี้วัดดังกล่าวเพื่อเปรียบเทียบผลการดำเนินงานของกองทุนรวม

### คำเตือน

- การลงทุนในกองทุนรวมไม่ใช่การฝากเงิน
- ผลการดำเนินงานในอดีตของกองทุนรวมมิได้เป็น  
สิ่งยืนยันถึงผลการดำเนินงานในอนาคต

การเข้าร่วมต่อต้านทุจริต: ได้รับการรับรองจาก CAC

จัดอันดับกองทุน Morningstar ★★★★★ (ข้อมูล ณ 30 ธ.ค. 2568)

หนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม



ผู้ลงทุนสามารถศึกษาเครื่องมือ  
บริหารความเสี่ยงด้านสภาพคล่อง  
ได้ในหนังสือชี้ชวนฉบับเต็ม

www.krungsriasset.com

| การซื้อขายหน่วยลงทุน                                        | การขายคืนหน่วยลงทุน                                                                                                                  |
|-------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| วันทำการซื้อ: ทุกวันทำการของธนาคาร                          | วันทำการขายคืน: ทุกวันทำการของธนาคาร                                                                                                 |
| เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.                              | เวลาทำการ: 08:30 น. - 15:30 น.                                                                                                       |
| การซื้อครั้งแรกขั้นต่ำ: 500 บาท สูงสุดไม่เกิน 500,000 บาท   | การขายคืนขั้นต่ำ: ไม่มี                                                                                                              |
| การซื้อครั้งถัดไปขั้นต่ำ: 500 บาท สูงสุดไม่เกิน 500,000 บาท | ยอดคงเหลือขั้นต่ำ: ไม่มี                                                                                                             |
|                                                             | ระยะเวลาการรับเงินค่าขายคืน: ภายใน 5 วันทำการ นับถัดจากวันทำการขายคืน โดยทั่วไปจะได้ รับเงิน 3 วันทำการนับถัดจากวันทำการขายคืน (T+3) |

| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากกองทุนรวม (% ต่อปี ของ NAV)                                                                                  |               |          |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------|
| ค่าธรรมเนียมต่อไปนี้จะส่งผลกระทบต่อผู้ลงทุน เนื่องจากจะทำให้ผลตอบแทนจากการลงทุนลดลง ดังนั้น ผู้ลงทุนควรตรวจสอบทุกครั้งก่อนตัดสินใจลงทุน |               |          |
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                            | สูงสุดไม่เกิน | เก็บจริง |
| การจัดการ                                                                                                                               | 2.6750        | 2.1400   |
| ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืน หน่วยลงทุนของกองทุนรวม (trailer fee): มี                                                    |               |          |
| รวมค่าใช้จ่าย                                                                                                                           | 5.0825        | 2.3405   |

| หมายเหตุ                                                                                                                                                        |                       |              |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------|--------------|
| ค่าตอบแทนแก่ผู้สนับสนุนการขายหรือรับซื้อคืนหน่วยลงทุน (trailer fee) เป็นส่วนหนึ่งของค่าธรรมเนียมการจัดการ                                                       |                       |              |
| ค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจากผู้ถือหน่วย (% ของมูลค่าซื้อขาย) ผู้ลงทุนจะถูกเรียกเก็บค่าธรรมเนียมต่อไปนี้อย่างตรงทุกครั้งเมื่อทำการซื้อขายหรือสับเปลี่ยนหน่วยลงทุน |                       |              |
| ค่าธรรมเนียม                                                                                                                                                    | สูงสุดไม่เกิน         | เก็บจริง     |
| การขาย                                                                                                                                                          | 1.50                  | ไม่เรียกเก็บ |
| การรับซื้อคืน                                                                                                                                                   | 1.50                  | ไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนเข้า                                                                                                                                     | 1.50                  | ไม่เรียกเก็บ |
| การสับเปลี่ยนหน่วยลงทุนออก                                                                                                                                      | 1.50                  | ไม่เรียกเก็บ |
| การโอนหน่วย                                                                                                                                                     | 10 บาทต่อ 1,000 หน่วย | ไม่เรียกเก็บ |
| ค่าปรับกรณีขายคืนและสับเปลี่ยนออก ก่อนระยะเวลาที่กำหนด                                                                                                          | 2.00                  | ไม่เรียกเก็บ |
| ค่าใช้จ่ายในการซื้อขายหลักทรัพย์ เมื่อมีการสั่งซื้อ ขาย สับเปลี่ยนหน่วยลงทุน                                                                                    | 0.50                  | 0.15         |

- หมายเหตุ
- ค่าธรรมเนียมดังกล่าวเป็นอัตราที่รวมภาษีมูลค่าเพิ่ม ภาษีธุรกิจเฉพาะหรือภาษีอื่นใดแล้ว
  - บริษัทจัดการอาจพิจารณาเปลี่ยนแปลงค่าธรรมเนียมที่เรียกเก็บจริงเพื่อให้สอดคล้องกับกลยุทธ์หรือค่าใช้จ่ายในการบริหารจัดการ

| ทรัพย์สินที่ลงทุน 5 อันดับแรก |       |
|-------------------------------|-------|
| Holding                       | % NAV |
| บมจ.ซีพี ออลล์                | 5.26  |
| บมจ.เอ็ม บี เค                | 5.24  |
| บมจ.ไมเนอร์ อินเตอร์เนชั่นแนล | 5.17  |
| บมจ.ทุนธนาชาติ                | 4.87  |
| บมจ.ศรีสวัสดิ์คอร์ปอเรชั่น    | 4.87  |

| ข้อมูลเชิงสถิติ            |                              |
|----------------------------|------------------------------|
| Maximum Drawdown           | -36.37 %                     |
| Recovering Period          | 0.00                         |
| FX Hedging                 | ยังไม่มีการลงทุนในต่างประเทศ |
| อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน | 0.40 เท่า                    |
| Sharpe Ratio               | -0.82                        |
| Alpha                      | -6.22 %                      |
| Beta                       | 0.93                         |
| Tracking Error             | N/A                          |

| สัดส่วนประเภททรัพย์สินที่ลงทุน (% NAV)            |       |
|---------------------------------------------------|-------|
| ตราสารทุนและหน่วยลงทุน                            | 99.12 |
| เงินฝาก หรือตราสารหนี้ที่สถาบันการเงิน เป็นผู้ออก | 0.97  |
| ทรัพย์สินอื่น                                     | 0.57  |
| หนี้สินอื่น                                       | -0.66 |

| การจัดสรรการลงทุนในกลุ่มอุตสาหกรรม (% NAV) |       |
|--------------------------------------------|-------|
| หมวดธนาคาร                                 | 13.24 |
| หมวดเงินทุนและหลักทรัพย์                   | 12.93 |
| หมวดพาณิชย์                                | 12.53 |
| หมวดขนส่งและ โลจิสติกส์                    | 11.62 |
| หมวดพลังงานและสาธารณูปโภค                  | 8.55  |

## คำอธิบาย

**Maximum Drawdown** เปรอ์เซ็นต์ผลขาดทุนสูงสุดของกองทุนรวมในระยะเวลา 5 ปีย้อนหลัง (หรือตั้งแต่จัดตั้งกองทุนกรณีที่ยังไม่ครบ 5 ปี) โดยวัดจากระดับ NAV ต่อหน่วยที่จุดสูงสุดไปจนถึงจุดต่ำสุดในช่วงที่ NAV ต่อหน่วยปรับตัวลดลง ค่า Maximum Drawdown เป็นข้อมูลที่ช่วยให้ทราบถึงความเสี่ยงที่อาจจะขาดทุนจากการลงทุนในกองทุนรวม

**Recovering Period** ระยะเวลาการฟื้นตัว เพื่อเป็นข้อมูลให้ผู้ลงทุนทราบถึงระยะเวลาดังแต่การขาดทุนสูงสุดจนถึงระยะเวลาที่ฟื้นกลับมาที่เงินทุนเริ่มต้นใช้ระยะเวลานานเท่าใด

**FX Hedging** เปรอ์เซ็นต์ของการลงทุนในสกุลเงินต่างประเทศที่มีการป้องกันความเสี่ยงจากอัตราแลกเปลี่ยน

**อัตราส่วนหมุนเวียนการลงทุน** ความถี่ของการซื้อขายหลักทรัพย์ในพอร์ตกองทุนในช่วงเวลาใดช่วงเวลาหนึ่ง โดยคำนวณจากมูลค่าที่ต่ำกว่าระหว่างผลรวมของมูลค่าการซื้อขายหลักทรัพย์กับผลรวมของมูลค่าการขายหลักทรัพย์ของกองทุนรวมในรอบระยะเวลา 1 ปีหารด้วยมูลค่า NAV ของกองทุนรวมเฉลี่ยในรอบระยะเวลาเดียวกัน กองทุนรวมที่มีค่า portfolio turnover สูง บ่งชี้ถึงการซื้อขายหลักทรัพย์บ่อยครั้งของผู้จัดการกองทุนและทำให้มีต้นทุนการซื้อขายหลักทรัพย์ที่สูง จึงต้องพิจารณาเปรียบเทียบกับผลการดำเนินงานของกองทุนรวมเพื่อประเมิน

ความคุ้มค่าของการซื้อขายหลักทรัพย์ดังกล่าว

**Sharpe Ratio** อัตราส่วนระหว่างผลตอบแทนส่วนเพิ่มของกองทุนรวมเปรียบเทียบกับความเสี่ยงจากการลงทุน โดยคำนวณจากผลต่างระหว่างอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมกับอัตราผลตอบแทนที่ปราศจากความเสี่ยง (risk-free rate) เปรียบเทียบกับค่าเบี่ยงเบนมาตรฐาน (standard deviation) ของกองทุนรวม ค่า Sharpe Ratio สะท้อนถึงอัตราผลตอบแทนที่กองทุนรวมควรได้รับเพิ่มขึ้นเพื่อชดเชยกับความเสี่ยงที่กองทุนรวมรับมา โดยกองทุนรวมที่มีค่า Sharpe Ratio สูงกว่าจะเป็นกองทุนที่มีประสิทธิภาพในการบริหารจัดการลงทุนที่ดีกว่า เนื่องจากได้รับผลตอบแทนส่วนเพิ่มที่สูงกว่าภายใต้ระดับความเสี่ยงเดียวกัน

**Alpha** ผลตอบแทนส่วนเกินของกองทุนรวมเมื่อเปรียบเทียบกับดัชนีชี้วัด (benchmark) โดยค่า Alpha ที่สูง หมายถึง กองทุนสามารถสร้างผลตอบแทนได้สูงกว่าดัชนีชี้วัด ซึ่งเป็นผลจากประสิทธิภาพของผู้จัดการกองทุนในการคัดเลือกหรือหาจังหวะเข้าลงทุนในหลักทรัพย์ได้อย่างเหมาะสม

**Beta** ระดับและทิศทางการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุน โดยเปรียบเทียบกับอัตราการเปลี่ยนแปลงของตลาด Beta น้อยกว่า 1 แสดงว่าหลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนน้อยกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด Beta มากกว่า 1 แสดงว่า หลักทรัพย์ในพอร์ตการลงทุนมีการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนมากกว่าการเปลี่ยนแปลงของอัตราผลตอบแทนของกลุ่มหลักทรัพย์ของตลาด

**Tracking Error** อัตราผลตอบแทนของกองทุนมีประสิทธิภาพในการเลียนแบบดัชนีชี้วัด โดยหาก tracking error ต่ำ หมายถึงกองทุนรวมมีประสิทธิภาพในการสร้างผลตอบแทนให้ใกล้เคียงกับดัชนีชี้วัด กองทุนรวมที่มีค่า tracking error สูง จะมีอัตราผลตอบแทนโดยเฉลี่ยห่างจากดัชนีชี้วัดมากขึ้น

**Yield to Maturity** อัตราผลตอบแทนจากการลงทุนในตราสารหนี้โดยถือจนครบกำหนดอายุ ซึ่งคำนวณจากดอกเบี้ยที่จะได้รับในอนาคตตลอดอายุตราสารและเงินต้นที่จะได้รับคืนนำมาคิดลดเป็นมูลค่าปัจจุบัน โดยใช้ตัวอัตราผลตอบแทนของกองทุนรวมตราสารหนี้ คำนวณจากค่าเฉลี่ยถ่วงน้ำหนักของ Yield to Maturity ของตราสารหนี้แต่ละตัวที่กองทุนมีการลงทุน และเนื่องจาก Yield to Maturity มีหน่วยมาตรฐานเป็นเปอร์เซ็นต์ต่อปี จึงสามารถนำไปใช้เปรียบเทียบอัตราผลตอบแทนระหว่างกองทุนรวมตราสารหนี้ที่มีนโยบายถือครองตราสารหนี้จนครบกำหนดอายุและมีลักษณะการลงทุนที่ใกล้เคียงกันได้

บริษัทหลักทรัพย์จัดการกองทุน กรุงศรี จำกัด

ที่อยู่ 898 อาคารเพลินจิตทาวเวอร์ ชั้น 1-2 โซนเอ ชั้น 12 ชั้น 18 โซนบี

ถนนเพลินจิต แขวงลุมพินี เขตปทุมวัน กรุงเทพฯ 10330

โทรศัพท์ 0-2657-5757 โทรสาร 0-2657-5777

เว็บไซต์: www.krungsriasset.com